

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 419.74
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 303.67

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index (SPI) vertreten sind. Large Caps werden passiv abgedeckt, Small & Mid Caps werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz der Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) und Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



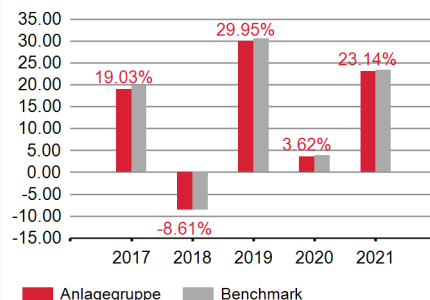
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-16.25%	4.75%	-4.57%	-11.73%	3.54%	5.11%	8.11%	5.41%
BENCHMARK	-16.06%	4.84%	-4.45%	-11.59%	3.81%	5.41%	8.52%	5.94%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	15.79	14.45	13.06	11.92	13.07
Volatilität Benchmark (in %)	-	14.51	13.10	11.97	13.43
Tracking Error ex post (in %)	0.28	0.32	0.31	0.30	1.21
Information Ratio	-0.48	-0.86	-0.98	-1.36	-0.51
Sharpe Ratio	-0.76	0.28	0.43	0.70	0.39
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.99	1.00	1.00	1.00	0.97
Jensen-Alpha	-0.19	-0.25	-0.28	-0.38	-0.36
Maximum Drawdown (in %)	-21.88	-25.88	-25.88	-25.88	-54.46
Recovery Period (Jahre)	-	0.83	0.83	0.83	4.97

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245481
ISIN: CH0012454812
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Bloomberg-Code: SWAAKCH SW
Benchmark: Swiss Performance Index
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/09/2001
Ausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passiv)
 Pictet Asset Management AG
Small&Mid Caps (aktiv)
 Privatbank Von Graffenried AG

Externe Beratung:

PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.53%
ex post per: 30/09/2022 0.53%

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
GESUNDHEITSWESEN	35.47%	36.34%
VERBRAUCHSGÜTER	26.43%	26.69%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	15.63%	14.84%
FINANZEN	15.02%	16.89%
GRUNDSTOFFE	2.23%	2.25%
TECHNOLOGIE	1.62%	1.25%
TELEKOMMUNIKATION	0.85%	0.97%
VERBRAUCHERSERVICE	0.44%	0.58%
VERSORGUNGSBETRIEBE	0.43%	0.19%
ERDÖL UND ERDGAS	-	-
LIQUIDITÄT	1.89%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NESTLE SA-REG	20.28%	20.31%
ROCHE HOLDING AG	15.81%	15.83%
NOVARTIS AG-REG	12.50%	12.51%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.35%	4.36%
UBS GROUP AG-REG	3.50%	3.51%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	3.46%	3.46%
ABB LTD-REG	3.06%	3.07%
LONZA GROUP AG-REG	2.60%	2.60%
SIKA AG	2.34%	2.35%
ALCON INC	2.06%	2.06%

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Anteil	Anzahl	Anteil	Anzahl
Grosse Unternehmen	81.34%	20	81.46%	20
Mittlere Unternehmen	16.09%	48	16.66%	80
Kleine Unternehmen	0.69%	5	1.88%	117
Liquidität	1.89%	-	-	-